

BAB III

METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian

Jenis penelitian yang dilakukan merupakan penelitian deskriptif kuantitatif, Penelitian ini merupakan penelitian yang bertujuan menjelaskan fenomena yang ada dengan menggunakan angka-angka untuk mencandarkan karakteristik individu atau kelompok (Syamsudin & Damiyanti: 2011). Penelitian ini menilai sifat dari kondisi-kondisi yang tampak. Tujuan dalam penelitian ini dibatasi untuk menggambarkan karakteristik sesuatu sebagaimana adanya.

B. Jenis Dan Sumber Data

Data yang di gunakan merupakan data sekunder yang bersifat berkala (*time series*) yang di peroleh dari Indikator Pembangunan Dunia. Kemudian diolah sesuai kebutuhan peneliti utuk mempermudah penelitian ini. Data yang di dapat adalah data aliran utang luar negeri, kurs/ nilai tukar dan penegluran pemerintah dari tahun 1970-2015.

C. Metode Pengumpulan Data

Metode pengumpulan data yang di gunakan adalah Teknik pengumpulan data dokumentasi, Dokumentasi adalah mencari dan mengumpulkan data mengenai hal-hal yang berupa catatan, transkip, buku, surat kabar, majalah, notulen, rapot, agenda dan sebagainya (Arikunto ,2006:158).

D. Definisi Oprasional Variabel

Dalam penelitian ini data yang digunakan terdapat dua katagori vaiabel yaitu: variabel terikat (Y) dam variabel bebas (x). variabel penelitian adalah suatu atribut, sifat, atau nilai dari orang obyek atau kegiatan yang mempunyai variasi tertentu yang ditetapkan oleh peneliti untuk dipelajari dan kemudian ditarik kesimpulan (Sugiyono, 2010:38).

a. Variabel terikat (*Dependent Variable*)

Variabel terikat adalah variabel yang dipengaruhi oleh variabel bebas (Burhan Bungin,2011; 72). Variabel terikat dalam penelitian ini adalah pengeluaran pemerintah, Pengeluaran PDB (konstanta US\$2000) dari sisi pengeluaran terdiri dari pengeluaran konsumsi akhir rumah tangga, pengeluaran konsumsi akhir pemerintah umum. Pengeluaran tersebut dicatat dalam harga pembelian dan termasuk pajak bersih atas produk. Data dalam konstanta 2000

b. Variabel Bebas (*Independent Variabel*)

Dalam penelitian ini terdapat dua variabel bebas yaitu utang luar negeri dan kurs tukar, yang mana Menurut Burhan Bungin (2011; 72) Variabel bebas adalah variabel yang menentukan arah atau perubahan tertentu pada variabel tergantung.

1. Utang Luar Negeri (X_1)

Utang luar negeri merupakan pinjaman yang di lakukan oleh Indonesia terhadap pihak luar yang di dapatkan secara bilateral maupun multilateral, utang swasta maupun utang pemerintah. Secara bilateral

merupakan usaha-usaha yang dilakukan secara individu oleh negara donor terhadap negara pendonor. multilateral berarti hutang tersebut diperoleh dari kelompok-kelompok negara yang tergabung dalam organisasi-organisasi seperti OECD, IMF, CGI, maupun Bank Dunia.

Data yang digunakan adalah data Arus bersih utang eksternal adalah pencairan utang luar negeri jangka panjang dan pembelian IMF dikurangi pembayaran pokok utang luar negeri jangka panjang dan pembelian kembali IMF.

2. Kurs Tukar (X_2)

Kurs/ nilai tukar adalah harga satu mata uang terhadap mata uang lainnya. Nilai tukar resmi mengacu pada nilai tukar yang ditentukan oleh otoritas nasional atau pada nilai yang ditentukan oleh pasar valas yang disetujui secara hukum. Nilai ini dihitung sebagai rata-rata tahunan berdasarkan rata-rata bulanan (unit mata uang lokal relatif terhadap dolar AS) Data yang digunakan adalah data yang ada pada indikator pembanguna dunia.

E. Metode Analisis

Untuk terpenuhinya tujuan penelitian, yaitu pengaruh utang luar negeri dan kur/nilai tukar terhadap pengeluaran pemerintah maka harus mendapatkan persamaan fungsi, sehingga alat analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisi regresi linier berganda dengan uji statistik klasik yaitu uji F, uji T, dan menggunakan metode estimasi didasarkan pada metode OLS (*Ordinary*

Least Square) (Sritua Arief, 1993 ; 2) Adapun persamaan regresi yang akan di uji adalah sebagai berikut :

$$Y = a + b_1.X_1 + b_2.X_2 + e$$

Dimana:

Y = pengeluaran pemerintah

a = konstanta

$b_1 + b_2$ = koefisien regresi

X_1 = utang luar negeri

X_2 = kurs/ nili tukar

e = nili residual

F. Teknik Analisi Data

1. Uji statistik

a. Uji T- Statistik

Uji (t) adalah uji statistik yang digunakan untuk menguji hubungan regresi secara parsial (berpengaruh atau tidak) (Gujarati, 1991). Derajat signifikansi yang di gunakan adalah 0,05 apabila nilai signifikan lebih kecil dari derajat kepercayaan maka kita akan menggunakan hipotesa alternatif, yang akan menyatakan bahwa variabel independent secara parsial mempengaruhi variabel dependent. Apabila ($t^* < t$ tabel), maka hipotesa nol tidak di tolak. Apabila ($t^* > t$ tabel), maka hipotesa nol di tolak. Sehingga semakin t^* maka makin kuat signifikan statistik membuktikan keterpengaruhanya (sumodinigrat,1995).

b. Uji F- Statistik

Uji F adalah uji statistik yang digunakan untuk menguji pengaruh variabel bebas secara keseluruhan terhadap variabel terikat dalam suatu model regresi. Derajat yang di kepercayaan yang digunakan 0,05 apabila nilai F hasil hitung lebih besar dibanding nilai F menurut tabel maka akan ada hipotesis alternatif. Bila $F^* > F_{\text{tabel}}$, maka H_0 ditolak dan bila H_a maka menerima dan tidak semu (β adalah nol) (soelistyo,2011).

c. Pengujian koefisien determinan (R^2)

Dalam uji ini bertujuan mengetahui seberapa baik garis regresi sample dalam kecocokan data. R^2 kemampuan model menerangkan variasi perubahan variabel terikat. Dari nilai koefisien determinasi (R^2) maka dapat dilihat seberapa besar kontribusi variabel bebas secara keseluruhan didalam menjelaskan variasi variabel terikat.

Nilai R^2 akan semakin tinggi dengan adanya jumlah variabel bebas yang semakin banyak, tetapi nilai derajat kebebasannya akan semakin kecil yang menyebabkan hasil regresi agak goyah. Sehingga dengan semakin tingginya tidak menjamin bahwa suatu model semakin mampu untuk menjelaskan variabel terikat. Oleh itu digunakan *Adjusted R-Square* (R^2) yang sudah memperhitungkan derajat kebebasan .

2. Uji asumsi klasik

Pengujian ini dilakukan untuk mengetahui apakah model yang estimasi telah memenuhi kriteria ekonometrik. Yaitu tidak terjadi pelanggaran-pelanggaran asumsi klasik. Pemenuhan asumsi klasik ini sebagai syarat untuk

mendapatkan estimasi parameter yang terbaik, tidak bias dan linier (Best Linier Unbiased Estimasi/BLUE).

Asumsi regresi linier klasik ini adalah sebagai berikut :

1. Rata-rata gangguan $E(u) = 0$.
2. Gangguan didistribusikan secara normal.
3. Gangguan tidak berkorelasi dengan variabel bebas.
4. Varian gangguan tetap atau kondisi Heteroskedastisitas.
5. Tidak terjadi Autokorelasi dalam gangguannya.
6. Tidak terjadi hubungan antar variabel penjelas (Multikolinieritas).

Asumsi-asumsi klasik tersebut harus terpenuhi sebelum lebih jauh menganalisa data yaitu meregresikan variabel terikat terhadap variabel bebas dengan metode Ordinary Least Square (OLS). Apabila terjadi penyimpangan-penyimpangan asumsi tersebut maka akan berkonsekuensi terhadap estimasi, adapun konsekuensinya akan dibahas dibawah ini.

Apabila terjadi penyimpangan dari asumsi pertama yaitu rata-rata gangguan tidak sama dengan nol maka akan menyebabkan estimasi terhadap besarnya konstanta dalam persamaan regresi akan menyimpang dari nilai sebenarnya. Tetapi penyimpangan estimasi konstanta tidak begitu mengganggu. Hal ini disebabkan karena besarnya koefisien arah (slope) yang menunjukkan besarnya pengaruh. Pelanggaran asumsi kedua, tidak terlalu berpengaruh kevalidan dan regresi. Jika yang dibutuhkan hanya untuk keperluan estimasi saja. Meskipun demikian masih dapat memungkinkan untuk memperoleh hasil estimasi OLS yang BLUE).

Penyimpangan asumsi ketiga ini biasanya akan ditemukan apabila menggunakan model simultan, sedangkan untuk model persamaan tunggal jarang sekali terjadi. Pengujian yang paling penting dan merupakan keharusan untuk mengestimasi dalam model regresi dengan metode OLS adalah asumsi ke 4, 5, 6 asumsi tersebut adalah keadaan homoskedastisitas, tidak terjadinya multikolonieritas dan tidak adanya autokorelasi

a. Uji Normalitas

Uji normalitas dilakukan untuk mengetahui apakah nilai residual (H) tersebut tersebar normal atau tidak (Gujarati, 1991 : 65). Prosedur uji dilakukan dengan Uji Kolmogorov-Smirnov. Jika nilai sig. (p-value) $> \alpha$ ($\alpha = 0,05$), maka H_0 diterima. Jika nilai sig. (p-value) $< \alpha$ ($\alpha = 0,05$), maka H_0 ditolak H_1 diterima yang artinya normalitas tidak terpenuhi.

b. Uji Linieritas

Uji linieritas dilakukan untuk mengetahui apakah spesifikasi data yang digunakan sudah benar atau tidak, dan memberitahukan informasi apakah fungsi yang digunakan pada penelitian berbentuk linier atau tidak. Uji linier, untuk menguji ini menggunakan Ramsey (Ramsey RESET Test)

c. Uji Multikolinieritas

Pemakaian metode OLS sebagai alat untuk mengestimasi koefisien regresi linier klasik disyaratkan harus lolos dari asumsi klasik yaitu terjadinya hubungan atau korelasi antara variabel penjualan (Multicollinearity) dalam suatu model regresi.

Pendeteksian kondisi Multikolineritas di dalam model regresi ini dengan menggerakkan pengujian Multikolineritas dengan Uji- t Farras Glauber yaitu untuk mengetahui variabel mana yang bertanggung jawab atau penyebab Multikolineritas.

Hipotesa yang akan diuji dengan uji t ini bahwa tidak ada hubungan antara hutang Luar Negeri dengan kurs sehingga hutang Luar Negeri dan kurs bukanlah penyebab Multikolineritas. Atau ada hubungan antara hutang Luar Negeri dengan perubahan nilai tukar / kurs sehingga hutang LN dengan nilai tukar / kurs adalah penyebab Multikolieritas.

d. Uji Autokorelasi

Asumsi yang harus dipenuhi untuk mengestimasi model regresi dengan Metode OLS / Ordinary Least Square adalah kondisi tidak adanya autokorelasi atau hubungan antara variabel gangguan pada periode lain. Keuntungan besar dari Statistik d adalah bahwa statistik tadi didasarkan pada residual yang ditaksir, yang secara rutin dihitung dalam Analisa regresi. Dalam mendeteksi autokorelasi model autoregresif ini penulis menggunakan Uji Durbin Waston-d.

e. Uji Heterokedastisitas

Kondisi tidak terjadinya Heteroskedastisitas terhadap data atau kondisi data yang Homoskedastisitas harus terpenuhi dalam mengestimasi koefisien regresi untuk mendapatkan hasil estimasi yang efisien.

Heteroskedastisitas adalah suatu keadaan dimana masing-masing variabel pengganggu memiliki varian yang berbeda pada periode penyampelan yang berulang-ulang. Apabila keadaan tidak terjadi, maka disebut Homoskedastisitas

Pengujian ini bertujuan untuk melihat apakah varian dari residual besarnya tetap atau konstan. Adanya Heteroskedastisitas ini tidak pernah berpengaruh terhadap ketidak biasan dan konsistensi estimator, tetapi persyaratan varian minimum tidak dicapai sepenuhnya sehingga dikatakan tidak efisien. Keadaan Heteroskedastisitas ini dapat dikurangi dengan jalan melakukan transformasi data ke dalam bentuk logaritma.

Dalam penelitian ini pendeteksian heteroskedastisitas digunakan metode Arch Test dengan jalan meregresikan nilai residual dengan residualnya. Dengan pengujian terhadap pemeriksa secara individual maupun serentak, namun yang diutamakan adalah Uji Serentak (F test). Tujuan dari heteroskedastisitas ini ingin menerima H_0 sehingga tidak terjadi heteroskedastisitas